

## 【表紙】

【提出書類】 有価証券報告書の訂正報告書

【提出先】 関東財務局長

【提出日】 令和2年7月31日

【計算期間】 第2期(自平成31年1月1日至令和元年12月31日)

【ファンド名】 レッド・アーク・グローバル・インベストメンツ(ケイマン)  
トラスト - 償還時目標設定型ファンド1802  
(Red Arc Global Investments (Cayman) Trust - Target Setting at Maturity Fund 1802)

【発行者名】 シティグループ・ファースト・インベストメント・  
マネジメント・リミテッド  
(Citigroup First Investment Management Limited)

【代表者の役職氏名】 取締役 ソン・リ  
(Song Li, Director)

【本店の所在の場所】 香港、セントラル、ガーデン・ロード3、  
チャンピオン・タワー50/F  
(50/F, Champion Tower,  
Three Garden Road, Central, Hong Kong)

【代理人の氏名又は名称】 弁護士 三浦 健

【代理人の住所又は所在地】 東京都千代田区丸の内二丁目6番1号 丸の内パークビルディング  
森・濱田松本法律事務所

【事務連絡者氏名】 弁護士 三浦 健  
同 飯村 尚久  
同 白川 剛士  
同 尾登 亮介

【連絡場所】 東京都千代田区丸の内二丁目6番1号 丸の内パークビルディング  
森・濱田松本法律事務所

【電話番号】 03(6212)8316

【縦覧に供する場所】 該当事項なし。

(注)米ドルおよび豪ドルの円換算額は、それぞれ便宜上、2020年4月30日現在における株式会社三菱UFJ銀行の対顧客電信売買相場の仲値(1米ドル=106.87円、1豪ドル=69.84円)による。以下別段の記載がない限りこれによる。

## 1【有価証券報告書の訂正報告書の提出理由】

令和2年6月30日付をもって提出した有価証券報告書の「第一部 ファンド情報、第1 ファンドの状況、5 運用状況、(3) 運用実績」において、2019年12月末日の純資産価額および1口当たり純資産価格が、管理事務代行会社による報告額ではなく財務書類作成のため調整された数値で記載されており、また収益率も当該数値に基づき算出されているため、これを訂正するため、本訂正報告書を提出するものです。

## 2【訂正の内容】

(注) 下線は訂正箇所を示します。

## 第一部 ファンド情報

## 第1 ファンドの状況

## 5 運用状況

## (3) 運用実績

## 純資産の推移

<訂正前>

(前略)

<米ドル建て受益証券>

	純資産総額		1口当たり純資産価格	
	(米ドル)	(千円)	(米ドル)	(円)
第1会計年度末 (2018年12月末日)	151,741,574.31	16,216,622	10.212	1,091
第2会計年度末 (2019年12月末日)	<u>116,844,494.02</u>	<u>12,487,171</u>	<u>10.920</u>	<u>1,167</u>
2019年5月末日	131,751,148.20	14,080,245	10.604	1,133
6月末日	128,102,136.48	13,690,275	10.797	1,154
7月末日	124,040,413.98	13,256,199	10.780	1,152
8月末日	121,383,704.70	12,972,277	10.711	1,145
9月末日	119,064,836.97	12,724,459	10.613	1,134
10月末日	117,209,856.70	12,526,217	10.577	1,130
11月末日	117,208,114.78	12,526,031	10.733	1,147
12月末日	<u>116,844,494.02</u>	<u>12,487,171</u>	<u>10.920</u>	<u>1,167</u>
2020年1月末日	113,685,554.41	12,149,575	10.867	1,161
2月末日	109,802,806.47	11,734,626	10.803	1,155
3月末日	100,792,159.80	10,771,658	10.133	1,083
4月末日	100,800,812.28	10,772,583	10.194	1,089

## &lt; 豪ドル建て受益証券 &gt;

	純資産総額		1口当たり純資産価格	
	(豪ドル)	(千円)	(豪ドル)	(円)
第1会計年度末 (2018年12月末日)	36,152,192.99	2,524,869	10.298	719
第2会計年度末 (2019年12月末日)	<u>28,608,196.83</u>	<u>1,997,996</u>	<u>11.173</u>	<u>780</u>
2019年5月末日	31,282,347.45	2,184,759	10.872	759
6月末日	31,041,663.29	2,167,950	11.010	769
7月末日	30,983,076.27	2,163,858	11.125	777
8月末日	30,325,628.57	2,117,942	11.013	769
9月末日	29,775,553.31	2,079,525	10.944	764
10月末日	29,232,205.80	2,041,577	10.876	760
11月末日	29,213,108.95	2,040,244	11.121	777
12月末日	<u>28,608,196.83</u>	<u>1,997,996</u>	<u>11.173</u>	<u>780</u>
2020年1月末日	27,912,440.69	1,949,405	11.256	786
2月末日	26,703,277.50	1,864,957	10.852	758
3月末日	24,367,320.71	1,701,814	10.306	720
4月末日	24,437,904.29	1,706,743	10.356	723

(注) 上記の純資産価額と1口当たり純資産価格は、管理事務代行会社による報告額である。

&lt;訂正後&gt;

(前略)

&lt;米ドル建て受益証券&gt;

	純資産総額		1口当たり純資産価格	
	(米ドル)	(千円)	(米ドル)	(円)
第1会計年度末 (2018年12月末日)	151,741,574.31	16,216,622	10.212	1,091
第2会計年度末 (2019年12月末日)	<u>117,656,955.04</u>	<u>12,573,999</u>	<u>10.996</u>	<u>1,175</u>
2019年5月末日	131,751,148.20	14,080,245	10.604	1,133
6月末日	128,102,136.48	13,690,275	10.797	1,154
7月末日	124,040,413.98	13,256,199	10.780	1,152
8月末日	121,383,704.70	12,972,277	10.711	1,145
9月末日	119,064,836.97	12,724,459	10.613	1,134
10月末日	117,209,856.70	12,526,217	10.577	1,130
11月末日	117,208,114.78	12,526,031	10.733	1,147
12月末日	<u>117,656,955.04</u>	<u>12,573,999</u>	<u>10.996</u>	<u>1,175</u>
2020年1月末日	113,685,554.41	12,149,575	10.867	1,161
2月末日	109,802,806.47	11,734,626	10.803	1,155
3月末日	100,792,159.80	10,771,658	10.133	1,083
4月末日	100,800,812.28	10,772,583	10.194	1,089

## &lt; 豪ドル建て受益証券 &gt;

	純資産総額		1口当たり純資産価格	
	(豪ドル)	(千円)	(豪ドル)	(円)
第1会計年度末 (2018年12月末日)	36,152,192.99	2,524,869	10.298	719
第2会計年度末 (2019年12月末日)	<u>28,909,539.25</u>	<u>2,019,042</u>	<u>11.291</u>	<u>789</u>
2019年5月末日	31,282,347.45	2,184,759	10.872	759
6月末日	31,041,663.29	2,167,950	11.010	769
7月末日	30,983,076.27	2,163,858	11.125	777
8月末日	30,325,628.57	2,117,942	11.013	769
9月末日	29,775,553.31	2,079,525	10.944	764
10月末日	29,232,205.80	2,041,577	10.876	760
11月末日	29,213,108.95	2,040,244	11.121	777
12月末日	<u>28,909,539.25</u>	<u>2,019,042</u>	<u>11.291</u>	<u>789</u>
2020年1月末日	27,912,440.69	1,949,405	11.256	786
2月末日	26,703,277.50	1,864,957	10.852	758
3月末日	24,367,320.71	1,701,814	10.306	720
4月末日	24,437,904.29	1,706,743	10.356	723

(注)上記の純資産価額と1口当たり純資産価格は、管理事務代行会社による報告額である。

## 収益率の推移

## &lt; 訂正前 &gt;

## &lt; 米ドル建て受益証券 &gt;

計算期間	収益率(注)
第1会計年度	2.12%
第2会計年度	<u>6.93%</u>

## &lt; 豪ドル建て受益証券 &gt;

計算期間	収益率(注)
第1会計年度	2.98%
第2会計年度	<u>8.50%</u>

(注) 収益率(%) =  $100 \times (a - b) / b$

a = 上記会計年度末の1口当たり純資産価格(当該会計年度の分配金(税引前)の合計額を加えた額)

b = 当該会計年度の直前の会計年度末の1口当たり純資産価格(分配落の額)(第1会計年度については、1口当たり当初発行価格(10.00米ドルおよび10.00豪ドル))

&lt;訂正後&gt;

&lt;米ドル建て受益証券&gt;

計算期間	収益率(注)
第1会計年度	2.12%
第2会計年度	7.68%

&lt;豪ドル建て受益証券&gt;

計算期間	収益率(注)
第1会計年度	2.98%
第2会計年度	9.64%

(注) 収益率(%) =  $100 \times (a - b) / b$ 

a = 上記会計年度末の1口当たり純資産価格(当該会計年度の分配金(税引前)の合計額を加えた額)

b = 当該会計年度の直前の会計年度末の1口当たり純資産価格(分配落の額)(第1会計年度については、1口当たり当初発行価格(10.00米ドルおよび10.00豪ドル))